宝盈货币市场证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈货币	
基金主代码	213009	
交易代码	213009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年8月5日	
报告期末基金份额总额	28,297,068,779.45份	
投资目标	在保持低风险与高流动性的基础上,追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金运用利率预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略等积极的投资策略相结合,对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略考虑各类资产的风险性、流动性及收益性特征,把风险控制在预算之内,在不增加风险的基础上保持高流动性,最终达到追求稳定的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	宝盈货币A	宝盈货币B
下属分级基金的交易代码	213009	213909
报告期末下属分级基金的份额总额	3,559,341,762.13份	24,737,727,017.32份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)	
	宝盈货币A	宝盈货币B
1. 本期已实现收益	26,023,989.89	215,717,872.58
2.本期利润	26,023,989.89	215,717,872.58
3.期末基金资产净值	3,559,341,762.13	24,737,727,017.32

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,本基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7526%	0.0064%	0.0882%	0.0000%	0.6644%	0.0064%

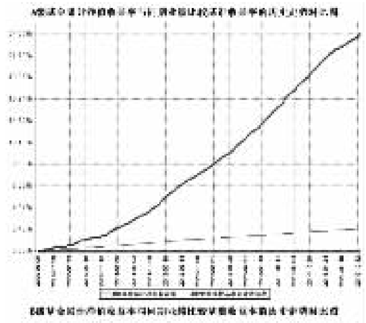
注:本基金收益分配按日结转份额。

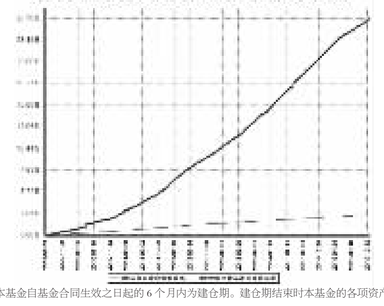
宝盈货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8137%	0.0064%	0.0882%	0.0000%	0.7255%	0.0064%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2009年8月5日	-	12年	陈若劲女士,香港中文大学金融MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作,2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
邱骏	本基金基金经理	2015年7月8日	-	5年	2010年7月加入宝盈基金管理有限公司,在固定收益部任职固定收益研究员,负责利率债、信用债、可转债等各类固定收益证券研究。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,尽管前期刺激措施频出,宏观经济数据依然未见改观。为缓解经济增长压力,央行宽松货币政策力度也持续加大,报告期内再度降准降息,降低企业融资成本,为经济增长提供宽松流动性环境。

报告期内,受益于宽松的货币政策,市场资金面整体相对充裕,即使IPO重启并延续老办法,也未对市场资金面带来明显扰动,资金利率仅在年末小幅上行。协议存款方面,除了年末商业银行报价有所提高外,其他时点商业银行对协议存款需求均较低。债券市场方面,收益率走势大致可分为三阶段,IPO重启消息发布前,收益率持续下行;IPO重启消息发布后,收益率快速大幅反弹,并一度超过报告期初水平;但收益率的反弹并未持续太久,随后在大量配置需求推动下,收益率再度恢复下行走势,并在年末创出全年最低水平。

报告期内,我们在IPO重启前整体维持了较高的债券类资产的配置比例和组合久期;IPO重启后,我们适当降低了债券类资产的配置比例和组合久期。年末随着债券市场收益率大幅下行,我们把握商业银行对协议存款的配置需求,增加协议存款配置以替代部分债券类资产。

4.5 报告期内基金的业绩表现

货币A:

本基金在本报告期内净值收益率是0.7526%,同期业绩比较基准收益率是0.0882%。

货币B:

本基金在本报告期内净值收益率是0.8137%,同期业绩比较基准收益率是0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	20,521,619,816.93	65.23
	其中:债券	20,521,619,816.93	65.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	10,610,742,982.86	33.73
4	其他资产	328,423,170.85	1.04
5	合计	31,460,785,970.64	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		15.57
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,136,894,003.55	11.09
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金《基金合同》中关于投资组合限制的约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天";且本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	27.01	11.09
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.10	-
2	30天(含)-60天	27.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.21	-
3	60天(含)-90天	12.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.14	-
4	90天(含)-180天	33.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	9.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.02	11.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,255,842,494.50	7.97
	其中:政策性金融债	2,255,842,494.50	7.97
4	企业债券	652,488,113.94	2.31
5	企业短期融资券	16,909,443,525.54	59.76
6	中期票据	703,845,682.95	2.49
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,521,619,816.93	72.52
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	694,881,514.91	2.46

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011551001	15中船SCP001	4,900,000	490,495,546.86	1.73
2	011522003	15神华SCP003	4,300,000	430,408,945.03	1.52
3	068007	06首都机场债	4,000,000	400,282,041.35	1.41
4	011517005	15华电SCP005	4,000,000	400,275,796.54	1.41
5	011599330	15国电集SCP005	4,000,000	400,024,359.23	1.41
6	011514006	15中粮SCP006	4,000,000	399,804,156.02	1.41
7	011537010	15中建材SCP010	3,900,000	389,850,235.11	1.38
8	130211	13国开11	3,800,000	380,060,549.50	1.34
9	011519005	15国电SCP005	3,600,000	360,531,379.47	1.27
10	130215	13国开15	3,600,000	360,086,784.90	1.27

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	29
报告期内偏离度的最高值	0.3053%
报告期内偏离度的最低值	0.1780%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2420%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用"摊余成本法"计价,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损益。

5.8.2 本报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	319,385,786.13
4	应收申购款	8,048,991.73
5	其他应收款	988,392.99
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	328,423,170.85

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	宝盈货币A	宝盈货币B
报告期期初基金份额总额	4,432,374,138.93	25,726,559,776.41
报告期期间基金总申购份额	7,359,605,265.57	29,617,249,649.98
报告期期间基金总赎回份额	8,232,637,642.37	30,606,082,409.07
报告期期末基金份额总额	3,559,341,762.13	24,737,727,017.32

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2015年10月8日	42,170.33	42,170.33	-
2	红利再投	2015年11月5日	35,852.61	35,852.61	-
3	红利再投	2015年12月7日	43,594.14	43,594.14	-
合计			121,617.08	121,617.08	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的文件。

《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》。

《宝盈货币市场证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

9.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2016年1月20日

鸿阳证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈鸿阳封闭
场内简称	基金鸿阳
基金主代码	184728
交易代码	184728
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2001年12月10日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和业绩优良而稳定的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好地分散和控制风险,在保持基金资产良好的流动性的基础上,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳利益。
投资策略	本基金股票投资包括两部分:一部分为成长型投资,另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系根据市场情况的变化进行调整,但对成长型或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总额的30%,最高均不得高于股票投资总额的70%。本基金将遵循流动性、安全性、收益性的原则,在综合分析宏观经济、行业、企业以及影响证券市场的各种因素的基础上确定投资组合,分散和降低投资风险,确保基金资产安全,谋求基金长期稳定的收益。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	风险水平和期望收益适中。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	73,046,773.49
2.本期利润	769,480,902.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.3847
4.期末基金资产净值	2,867,217,083.35
5.期末基金份额净值	1.4336

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

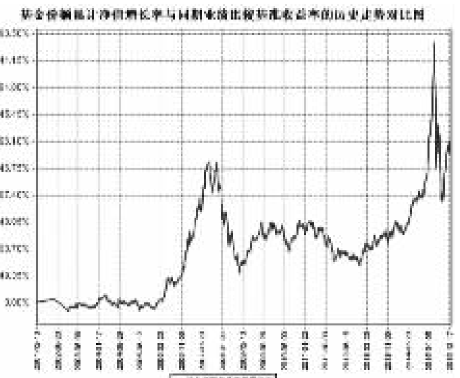
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	36.68%	3.36%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨凯	本基金基金经理、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈优势产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、副总经理	2013年2月5日	-	11年	杨凯先生,中山大学岭南学院工商管理硕士。2003年7月至今在宝盈基金管理有限公司工作,先后担任产品设计师、市场部总监、特定客户资产管理部投资经理、总监,研究部总监,总经理助理等职务。现任宝盈基金管理有限公司副总经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

经历了2015年三季度的大幅下跌之后,在政府系列救市措施的支持下,A股在四季度出现了较大幅度的反弹,风格指数差异较大,整体反弹以小市值、前期跌幅较大的个股为主。在此期间,创业板指数反弹30.32%,HS300指数反弹16.49%。本基金持股风格相对偏成长股,大盘监筹相对较小,在三季度股票大幅下跌的过程中,成长股集中度更高,本基金净值在四季度反弹幅度为36.68%。

报告期内,本基金没有遭遇较大的赎回压力,对仓位没有做太大的调整。操作上主要卖出或减持了三季度增持较多的个股、涨幅较大的个股。同时在指数反弹过程中,买入了相对涨幅较小的个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是36.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,256,371,945.11	76.96
	其中:股票	2,256,371,945.11	76.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	583,930,926.70	19.92
	其中:债券	583,930,926.70	19.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	84,107,725.80	2.87
8	其他资产	7,397,163.08	0.25
9	合计	2,931,807,760.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,346,321,697.52	46.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	194,385,505.95	6.78
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	288,018,631.70	10.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	115,096,932.84	4.01
L	租赁和商务服务业	64,471,680.00	2.25
M	科学研究和技术服务业	35,584,688.20	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	122,853,780.00	4.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	89,639,028.90	3.13
	合计	2,256,371,945.11	78.70

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002368	太极股份	4,278,691	287,100,166.10	10.01
2	002482	广田股份	5,562,135	162,692,448.75	5.67
3	002549	凯美特气	9,750,300	122,853,780.00	4.28
4	300396	迪瑞医疗	2,546,823	122,272,972.23	4.26
5	002698	博实股份	4,000,000	117,320,000.00	4.09
6	300090	盛运环保	9,999,782	117,097,447.22	4.08
7	002019	亿帆鑫富	2,772,920	110,916,800.00	3.87
8	300077	国民技术	2,169,816	98,032,286.88	3.42
9	300053	欧比特	2,218,481	90,403,100.75	3.15
10	600260	凯乐科技	5,999,935	89,639,028.90	3.13

注:报告期末本基金持有的太极股份自2015年5月14日起开始停牌,受市场波动及基金规模变动等影响,本基金持有的太极股份占基金资产净值比例被动超过10%。该股票于2015年12月31日复牌,本基金管理人将按照法律法规及基金合同的相关规定及时做出调整。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	553,887,926.70	19.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,043,000.00	1.05
	其中:政策性金融债	30,043,000.00	1.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	583,930,926.70	20.37

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010303	03国债(3)	3,641,430	378,271,748.40	13.19
2	010107	21国债(7)	1,489,710	161,529,255.30	5.63
3	110212	11国开12	200,000	20,014,000.00	0.70
4	010213	02国债(13)	139,890	14,086,923.00	0.49
5	150211	15国开11	100,000	10,029,000.00	0.35

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,759,082.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,638,080.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,397,163.08

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002698	博实股份	117,320,000.00	4.09	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	份额
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.25

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准鸿阳证券投资基金设立的文件。

《鸿阳证券投资基金基金合同》。

《鸿阳证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

8.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2016年1月20日

宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈科技30混合
基金主代码	000698
交易代码	000698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月13日
报告期末基金份额总额	2,625,674,049.28份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置,重点投资于以科学技术创新为动力、在产业竞争中掌握核心竞争优势的科技主题优质上市公司,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-273,986,305.52
2.本期利润	1,662,546,066.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.5899
4.期末基金资产净值	5,030,823,175.85
5.期末基金份额净值	1.916

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	43.09%	2.44%	12.18%	1.03%	30.91%	1.41%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭敢	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;总经理助理;投资部总监	2014年8月13日	-	14年	彭敢先生,金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第四季度A股市场表现较为稳健的反弹走势,上证指数、沪深300、深成指和创业板均出现稳步上扬,分别上涨15.93%、16.49%、27.35%和28.12%,本季度指数走势让市场重新恢复活力,成交量也逐渐企稳。本基金在四季度实现收益43.09%,为持有人获得较为理想的投资收益。

本基金管理人认为,本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑,虽然从实体经济的增速来看,中国经济仍然在持续的下滑调整过程中,政府需要通过各种货币政策工具操作来降低实体经济利率,同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级;从整体来看,政府依然能有决心实现稳步的经济增长,同时也全面支持发展新兴产业,无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展,都能体现国家对经济结构转型升级的决心。在前四季度,本基金管理人一直以代表经济转型的战略性新兴产业个股作为重点投资标的,虽然结果来看投资收益不能算顶级,但基本能按照本基金管理人的投资理念来执行,虽然经历了三季度市场系统性下跌,管理人也未能幸免于下跌,但在较低位置主动参与了反弹,并取得了不错的效果。

2015年四季度A股经历了三季度剧烈震荡后逐渐企稳,政府通过大量救市资金入市和上市公司限制减持等措施让市场取得了阶段性稳定市场效果;从资金面来分析,从改革转型叠加杠杆资金市场导致过快上涨的市场出现了大幅调整,较多的杠杆资金在三季度加速撤离市场,但是在四季度出现了稳定,基本表现为存量资金在市场博弈态势;从公司基本面来分析,三季度大多数上市公司并未出现季报业绩低于预期的情况,甚至不少新兴成长公司三季报业绩大幅超预期,也成为市场新的龙头;从过往历史来看,基金管理人一直坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来操作,在板块选择上坚持选择与过往市场不同的新的投资方向和新成长主题,虽然由此也丧失了一些投资机会,也未能将提前布局的优质成长股收益最大化等,但从整体结果来看,较为理想。季度末主要持仓集中在医药、军工、新能源、TMT、农业、环保等方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是43.09%,同期业绩比较基准收益率是12.18%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,692,004,320.86	92.26
	其中:股票	4,692,004,320.86	92.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	236,666,664.30	4.65
	其中:债券	236,666,664.30	4.65
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	130,521,144.22	2.57
8	其他资产	26,351,854.87	0.52
9	合计	5,085,543,984.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	439,500,304.31	8.74
B	采矿业	46,654,063.56	0.93
C	制造业	2,937,766,843.98	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	44,195,832.80	0.88
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	893,813,678.29	17.77
J	金融业	36,000,000.00	0.72
K	房地产业	51,637,605.50	1.03
L	租赁和商务服务业	102,860,215.44	2.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	79,886,633.40	1.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	59,689,143.58	1.19
S	综合	-	-
	合计	4,692,004,320.86	93.27

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300252	金信诺	7,767,660	313,813,464.00	6.24
2	300094	国联水产	11,528,781	290,525,281.20	5.77
3	002522	浙江众成	14,270,875	264,439,313.75	5.26
4	300047	天源迪科	7,658,351	222,858,014.10	4.43
5	603456	九洲药业	3,124,994	219,802,323.34	4.37
6	002023	海特高新	11,201,000	205,426,340.00	4.08
7	002368	太极股份	2,968,947	199,216,343.70	3.96
8	300170	汉得信息	10,000,000	198,500,000.00	3.95
9	002773	康弘药业	1,843,931	151,571,128.20	3.01
10	002184	海得控制	3,321,762	142,868,983.62	2.84

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	236,666,664.30	4.70
	其中:政策性金融债	236,666,664.30	4.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,666,664.30	4.70

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	2,366,430	236,666,664.30	4.70

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内除九洲药业(代码:603456)、国联水产(代码:300094)外未受到公开谴责、处罚。

2015年1月17日,浙江九洲药业股份有限公司(以下简称"公司")位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故,造成1名工人受伤,经抢救无效死亡。事故发生后,公司立即启动突发事件应急处置预案,并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内,未对公司生产经营造成重大影响,也未对公司的经营业绩产生较大影响。2015年4月22日,公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书,认定该事故为一般生产安全责任事故,给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司预计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在事故发生后及处罚决定下达后未做减持。

2015年12月21日,深交所发布《关于对湛江国联水产开发股份有限公司及相关当事人给予通报批评的决定》。湛江国联水产开发股份有限公司(以下简称"国联水产")及相关当事人存在以下违规行为:国联水产披露的2014年度业绩快报的财务数据与2014年年报披露的财务数据相比,净利润相差较大,且业绩快报修正公告的披露时间严重滞后。国联水产董事长李忠、董事兼总经理陈汉、董事兼副总经理、时任财务总监吴丽青未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,上述行为均违反了《创业板股票上市规则(2014年修订)》相关规定,相关当事人对上市公司的违规行为负有重要责任。鉴于上述违规事实和情节,深交所对上市公司及相关当事人做出通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案,向社会公布。此次事件短期内对上市公司的上一年度经营业绩产生了影响,但对当季不产生影响,并且从长期看,不影响公司的后续发展和战略规划。我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在通报批评决定下达后未做减持。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,292,072.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,689,194.52
5	应收申购款	6,370,587.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,351,854.87

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603456	九洲药业	11,806,000.00	0.23	非公开发行

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,941,339,095.09
报告期期间基金总申购份额	498,901,519.18
减:报告期期间基金总赎回份额	814,566,564.99
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,625,674,049.28

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金设立的文件。

《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

《宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

9.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2016年1月20日